

AGRE - ASSESSORIA E GESTÃO DE RISCO A EMPRESAS

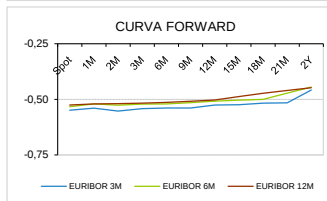
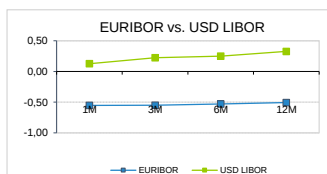
derivados.caixabi@caixabi.pt - 21 313 73 26

RENTA FIXA

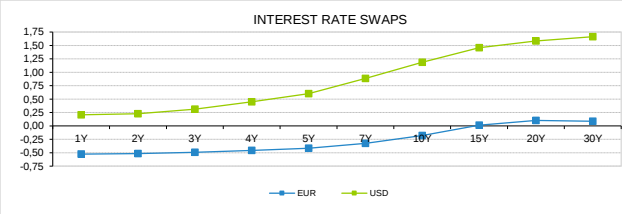
INTERBANK OFFERED RATES									
EURIBOR	FIXING	1D (bps)	1M (bps)	USD LIBOR	LAST PRICE	1D (bps)	1M (bps)	GBP LIBOR	CHF LIBOR
1M	-0,5530	-1	0	1M	0,1260	0	-3	0,0258	-0,8124
3M	-0,5490	0	-1	3M	0,2245	0	1	0,0275	-0,7714
6M	-0,5300	-1	-1	6M	0,2503	0	0	0,0343	-0,7262
12M	-0,5060	0	-1	12M	0,3269	0	-1	0,0701	-0,6092

INTEREST RATE SWAPS						
EUR	LAST	1D (bps)	1M (bps)	1Y	3Y	5Y
1Y	-0,5256	0	1	-0,5075	-0,3534	-0,1579
2Y	-0,5147	1	3	-0,4767	-0,3036	-0,1041
3Y	-0,4922	1	5	-0,4354	-0,2562	-0,0527
4Y	-0,4570	2	7	-0,3896	-0,2044	0,0007
5Y	-0,4167	2	8	-0,3433	-0,1535	0,0550
7Y	-0,3267	3	10	-0,2444	-0,0485	0,1375
10Y	-0,1795	3	12	-0,0972	0,0781	0,2264
15Y	0,0143	3	13	0,0736	0,1866	0,2726
20Y	0,1020	3	14	0,1353	0,1986	0,2417
30Y	0,0880	3	16	0,1003	0,1242	0,1364

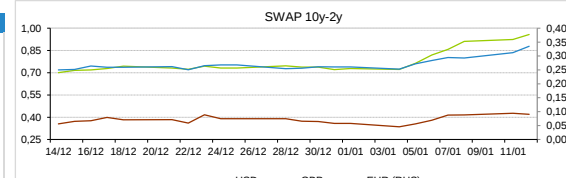
TAXA DE REFERÊNCIA BANCO CENTRAL	
Zona Euro	0,00
EUA	0,25
Reino Unido	0,10
Japão	0,10
Canadá	0,25
Suíça	-0,75
China	5,75
Brasil	2,00
Austrália	0,10
Índia	3,00



INTEREST RATE SWAPS				FORWARDS		
USD	LAST	1D (bps)	1M (bps)	1Y	3Y	5Y
1Y	0,2070	1	2	0,2516	0,8697	1,5281
2Y	0,2273	1	3	0,3643	1,0487	1,5915
3Y	0,3110	2	7	0,5298	1,1830	1,6830
4Y	0,4488	2	13	0,6875	1,3295	1,7533
5Y	0,6019	3	18	0,8475	1,4175	1,8068
7Y	0,8849	4	25	1,1065	1,5565	1,8560
10Y	1,1846	5	29	1,3687	1,7145	1,8600
15Y	1,4563	4	30	1,5807	1,7600	1,9300
20Y	1,5820	4	31	1,6500	1,8475	1,9547
30Y	1,6628	4	30	1,6640	1,8128	1,8606

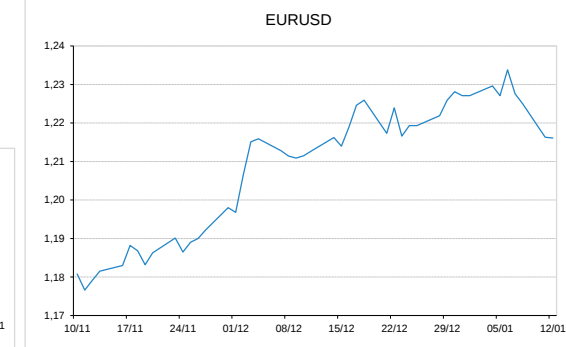
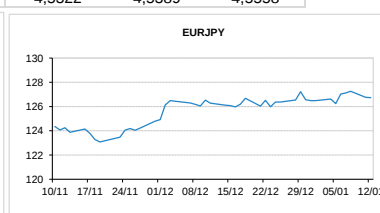


COMMODITIES	LAST	Var. 1D	Var. 1M	BONDS	YIELD	1D (bps)	1M (bps)
BRENT	56,62	0,96	6,72	OT 2Y	-0,671	0,01	6,60
JETFUEL	468,77	-2,76	40,77	OT 5Y	-0,409	0,03	8,10
DIESEL	453,51	-1,06	38,26	OT 10Y	0,042	0,05	8,00
COBRE	7.845,50	-267,00	91,50	BUND 10Y	-1,167	2,93	14,50
ZINCO	2.743,50	-47,00	-34,25	SCHATZ 2Y	-0,112	0,91	8,90
OURO	1.843,08	-5,64	3,23	T-NOTE 10Y	2,000	3,02	18,30
TRIGO	647,50	12,75	33,00	T-NOTE 2Y	0,743	0,74	2,80
LICENÇA C02	34,82	0,29	4,09	GILT 10Y	0,531	3,91	18,00



CAMBIAL

CAMBIAL	FIXING	Var. 1D	Var. 1M	FW 3M	FW 6M	FW 12M
EUR/USD	1,2161	-0,02%	-0,01%	1,2186	1,2210	1,2265
EUR/GBP	0,8944	0,89%	1,41%	0,8957	0,8971	0,8998
EUR/JPY	126,74	0,02%	-0,50%	126,74	126,74	126,74
EUR/CHF	1,0824	-0,05%	-0,48%	1,0817	1,0810	1,0797
EUR/BRL	6,5866	1,56%	-5,64%	6,6164	6,6579	6,8047
EUR/PLN	4,5268	-0,04%	-1,95%	4,5322	4,5389	4,5558



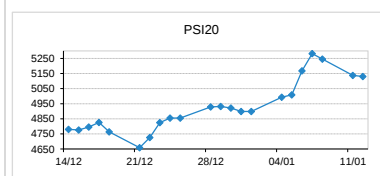
FIXINGS CONTRA USD e EUR

	EUR	USD	GBP	JPY	CHF	SEK	DKK	CAD	AUD	BRL	NOK
EUR	-	1,2161	0,8944	126,74	1,0824	10,0815	7,4396	1,5508	1,57441	6,5866	10,3610
USD	0,8225	-	0,7341	104,185	0,8894	8,2871	6,1180	1,2765	1,2944	5,4378	8,5228

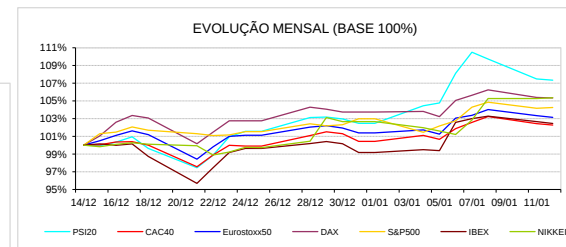
ACCIONISTA

TÍTULO	COTACÃO	1D %	YTD %
ALTRI	5,285	0,48	2,42
BCP	0,138	3,68	11,93
CORT. AMORIM	11,240	1,81	-3,10
CTT	2,435	1,67	3,62
EDP	5,400	-2,67	4,73
EDP R	23,350	-3,71	2,41
GALP	9,504	3,10	8,57
IBERSOL	5,080	-0,39	-5,93
J MARTINS	14,565	-1,49	5,39
MOTA ENGIL	1,504	5,62	10,26
NAVIGATOR	2,572	1,42	2,96
NOVABASE	3,370	2,74	4,98
NOS	3,116	1,50	9,03
PHAROL	0,138	4,55	10,42
REN	2,395	-0,42	1,27
SEMAPA	9,150	1,89	1,67
SONAE SGPS	0,688	1,33	3,93

MAIORES GANHOS/PERDAS	
Título	Variação %
MOTA ENGIL	5,62
PHAROL	4,55
BCP	3,68
GALP	3,10
NOVABASE	2,74
IBERSOL	-0,39
REN	-0,42
J MARTINS	-1,49
EDP	-2,67
EDP R	-3,71



ÍNDICE	LAST	Var. 1D	YTD%	MAX Anual	MIN Anual
PSI 20	5.130,97	-0,14%	4,75%	5.454,21	3.500,02
CAC40	5.653,92	-0,15%	1,85%	6.111,41	3.632,06
ESTX 50 PR	3.613,92	-0,18%	1,73%	3.867,28	2.302,84
XTRA DAX	13.928,69	-0,06%	1,53%	14.131,52	8.255,65
S&P 500	3.802,13	0,08%	1,24%	3.826,69	2.191,86
IBEX 35	8.340,10	-0,21%	3,30%	10.100,20	5.814,50
NIKKEI 225	28.164,34	0,09%	2,62%	28.287,37	16.358,19



A informação mencionada é meramente indicativa e reflecte o mercado pelas 16h30. As opiniões emitidas não podem ser entendidas como conselho ou recomendação para a prática de qualquer acto. A informação foi recolhida de fontes consideradas fiáveis, não se responsabilizando, no entanto, o CaixaBI por quaisquer incorrecções que as mesmas possam conter. Para mais informações, contactar a Sala de Mercados (Assessoria e Gestão de Risco a Empresas) do CaixaBI.

2017 © Caixa - Banco de Investimento, SA. Todos os direitos reservados.

O Caixa - Banco de Investimento, S.A. é membro da Euronext e é um intermediário financeiro registado na CMVM com o número 102.